易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
二〇一四年十月

重要提示

本基金经2012年12月31日中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1762号文核准募集。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于2013年3月6日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。证券投资基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。本基金属股票型基金,其风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在股票型基金中属于指数型基金,主要采用完全复制法紧密跟踪标的指数的表现,本基金的业绩表现与沪深300指数的表现密切相关。

证券投资基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。

本基金按照基金份额初始面值1.00元发售,在市场波动等因素的影响下,基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

因折算、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。本基金以1元初始面值开展基金募集或因折算、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值或1元附近,在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,并承担基金投资中出现的各类风险,包括市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。特有风险包括:指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪偏离度和跟踪误差的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、本基金场内外份额申购赎回对价方式不同的风险、基金场内份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场流动性风险、退市风险、第三方机构服务的风险等。

对于场内申购:投资者申购的基金份额当日可卖出,当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回;即在目前结算规则下,T日申购的基金份额当日可卖出,T日申购当日未卖出的基金份额,T+1日不得卖出和赎回,T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到影响。

场外申购赎回业务的申购费率、赎回费率可能会根据市场交易佣金水平、印花税率等相关交易成本的变动而调整。投资者在办理场外申购、赎回业务时之前仔细阅读本基金的招募说明书及基金管理人的相关公告。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守,诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。当投资人赎回时,所得会高于或低于投资人先前所支付的金额。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构购买和赎回基金,基金销售机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2014年9月6日,有关财务数据截止日为2014年6月30日,净值表现截止日为2014年6月30日。(本报告中财务数据未经审计)

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1.基金管理人:易方达基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43F
法定代表人:叶俊英
设立日期:2001年4月17日
注册资本:12,000万元人民币
联系人:贺晋
联系电话:4008818088

2.股权结构:

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总计	100%

(二)主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员

叶俊英先生,经济学博士,董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长,广东省烟草专卖局专卖办公室干部,广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁,易方达基金管理有限公司总裁、董事、副董事长。现任易方达基金管理有限公司董事长。

刘晓艳女士,经济学博士,董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理,基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理,易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司董事、总裁,易方达资产管理(香港)有限公司董事长。

秦力先生,经济学博士,董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理。现任广发证券股份有限公司董事、常务副总经理,广发控股(香港)有限公司董事,广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。

杨力先生,高级管理人员工商管理硕士(EMBA),董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理,佛山顺德百年科技有限公司行政总监,美的空调深圳营销中心区域经理,佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理,长虹空调广州营销中心营销总监,广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事,开源证券有限责任公司副董事长,盈峰资本管理有限公司总经理。

刘东辉先生,管理学博士,董事。曾任广州市东建实业总公司发展部投资计划员,广州商贸中心(马来西亚)有限公司副总经理、董事总经理,广州东建南洋经贸发展有限公司董事总经理,广东粤财信托有限公司综合管理部副总经理、信托管理三部副总经理。现任广东粤财信托有限公司总经理助理、信托管理三部总经理。

谢亮先生,高级管理人员工商管理硕士(EMBA),董事。曾任53011、53061部队财务部门助理员,广州军区生产管理部财务部门助理员、处长,广东省广晟资产经营有限公司总经理助理兼计划财务部部长,中国电信股份有限公司董事。现任广东省广晟资产经营有限公司副总经理,深圳中金岭南股份有限公司董事。

王化成先生,经济学博士,独立董事。曾任中国人民大学商学院助教、讲师、副教授。现任中国人民大学商学院教授、博士生导师。

何小锋先生,经济学硕士,独立董事。曾任广东省韶关市教育局干部,中共广东省韶关市委宣传部干部,北京大学经济学院讲师、副教授、金融系主任。现任北京大学经济学院教授、博士生导师。

朱征夫先生,法学博士,独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融房地产部主任,广东大陆律师事务所合伙人,广东省国土厅广东地产法律咨询服务中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

陈国祥先生,经济学硕士,监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理,广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理,易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李韵金先生,经济学硕士,监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记,中国证监会广州证管办处长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理,广州市广永国有资产经营有限公司董事长,万联证券有限责任公司董事长,广州银行副董事长、广州股权交易中心有限公司董事长,立根融资租赁有限公司董事长,广州立根小额再贷款股份有限公司董事长。

廖智先生,经济学硕士,监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管,易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理。现任易方达基金管理有限公司互联网金融部总经理。

张庆造先生,工商管理硕士(MBA),常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理,广东证券公司发行上市部经理、深圳证券业务部总经理、基金部总经理,易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

肖坚先生,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司职员,香港安财投资有限公司财务部经理,粤信(香港)投资有限公司业务部副经理,广东粤财信托投资公司基金部经理,易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、总裁助理、专户投资总监、专户首席投资官;基金科翔基金经理,易方达策略成长证券投资基金基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理、投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁,易方达资产管理有限公司董事长。

陈彤先生,经济学博士,副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员,易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生,高级管理人员工商管理硕士(EMBA),副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员,深圳众大投资有限公司投资部副总经理,广发证券有限责任公司研究员,易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官;基金科讯基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼固定收益总部总经理、现金管理部总经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事、人民币合格境外投资者(RQFII)业务负责人、证券交易负责人员(RO)、就证券提供意见负责人员(RO)、提供资产管理负责人员(RO)。

张南女士,经济学博士,督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长,易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范辰先生,工商管理硕士(MBA),首席产品执行官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员,深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理,深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品执行官,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

2. 基金经理

林飞先生,经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理,易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理,易方达沪深300指数证券投资基金基金经理(2009年8月26日至2010年12月31日)。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理,易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理(自2006年7月4日起任职)、易方达50指数证券投资基金基金经理(自2007年2月10日起任职)、易方达深证100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2009年12月1日起任职)、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(自2013年3月6日起任职)、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2013年9月23日起任职)、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年6月26日起任职),兼任易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员(RO)、提供资产管理负责人员(RO)。

林伟斌先生,经济学博士。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员,易方达基金管理有限公司指数与量化投资部指数量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(自2013年3月6日起任职)、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理(自2013年11月14日起任职)、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理(自2013年11月29日起任职)、兼易方达资产管理(香港)有限公司基金经理。

3. 指数与量化投资决策委员会成员

本公司指数与量化投资决策委员会成员包括:林飞先生、罗山先生、张胜记先生。

林飞先生,同上。

罗山先生,天体物理学博士。曾任巴克莱银行组约分行衍生品交易部董事、新加坡分行信用产品交易部董事,苏格兰皇家银行香港分行权益及信用产品部总经理,加拿大皇家银行香港分行结构化产品部总经理,诚信资本合伙人,五矿证券公司副总裁,安信证券资产管理部副总经理,易方达基金管理有限公司指数及量化投资部资深投资经理。现任易方达基金管理有限公司指数及量化投资部副总经理、易方达沪深300量化增强证券投资基金基金经理。

张胜记先生,管理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金(原易方达沪深300指数证券投资基金)基金经理。现任易方达基金管理有限公司易方达上证中盘交易型开放式指数基金基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理,兼任易方达资产管理(香港)有限公司基金经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1.基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010)67595096

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1.场内申购、赎回代办证券公司(以下排序不分先后)

(1) 广发证券
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41、42、43楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
客户服务电话:95575
开放式基金业务传真:020-87555305
网址:www.gf.com.cn

(2) 长江证券
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
联系人:李良
联系电话:027-65799999
客户服务电话:95579、4008-888-999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com

(3) 东方证券
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:胡月茹
联系电话:021-63325888
客户服务电话:95503
传真:021-63326729
网址:www.dfzq.com.cn

(4) 东海证券
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
联系人:樊旭
联系电话:021-20333333
客户服务电话:95531;400-888-8588
传真:021-50498825
网址:www.longone.com.cn

(5) 光大证券
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨、李芳芳
联系电话:021-22169999
客户服务电话:95525、400-8888-788、10108998
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com

(6) 华安证券
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市南二环959号财智中心B1座
法定代表人:李工
联系人:甘霖
联系电话:0551-65161666
客户服务电话:96518(省内)、400-80-96518(全国)
开放式基金业务传真:0551-65161672
网址:www.hazq.com

(7) 平安证券
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区金田路名卡中华国际交易广场8楼
法定代表人:谢永林
联系人:郑舒丽
客户服务电话:95511-8
开放式基金业务传真:0755-82400862
网址:www.pingan.com

(8) 齐鲁证券
注册地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
联系电话:0531-68889155
客户服务电话:95538
传真:0531-68889185
网址:www.qlzq.com.cn

(9) 申银万国证券
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层
法定代表人:储晓明
联系人:曹晔
联系电话:021-33389888
客户服务电话:95523、4008895523
传真:021-33388214
网址:www.swsc.com.cn

(10) 西南证券
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
联系电话:023-63786633
客户服务电话:4008096096
传真:023-63786212
网址:www.swsc.com.cn

(11) 银河证券
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:宋明
联系电话:010-66568450
客户服务电话:4008-888-8888
传真:010-66568990
网址:www.chinastock.com.cn

(12) 中信建投证券
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
开放式基金咨询电话:95587
开放式基金业务传真:010-65182261
网址:www.csc108.com

(13) 中信证券
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:顾凌
联系电话:010-60838696
传真:010-60833739
网址:www.citic.com

2.二级市场交易代办证券公司

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

3. 场外份额销售机构

直销机构:易方达基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43F
法定代表人:叶俊英
电话:020-85102506
传真:4008818099
联系人:温海萍
网址:www.efunds.com.cn

直销机构网点信息:

(1) 易方达基金管理有限公司广州直销中心
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼
电话:020-85102506
传真:400 881 8099
联系人:温海萍

(2) 易方达基金管理有限公司北京直销中心
办公地址:北京市西城区金融大街20号B座8层
电话:010-63213377
传真:400 881 8099
联系人:魏巍

(3) 易方达基金管理有限公司上海直销中心
办公地址:上海市世纪大道88号金茂大厦2706-2708室
电话:021-50476668
传真:400 881 8099
联系人:于楠

(二)登记结算机构

1. 场内份额登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人:周明
联系人:郑奕莉
电话:(021)58872935
传真:(021)68870311

2.场外份额登记结算机构
名称:易方达基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43F
法定代表人:叶俊英
成立时间:2001年4月17日
客户服务电话:400 881 8088(免长途话费)
传真:(020)38799249
联系人:余贤高

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬

(四)审计基金财产的会计师事务所

会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:薛竞、沈兆杰
联系人:沈兆杰

四、基金的名称

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:交易型、开放式、指数证券投资基金。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、基金的投资方向

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、一级市场股票(包括首次公开发行或增发)、债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、回购、中期票据等)、银行存款(包括银行定期存款、通知存款或大额存单等)、资产支持证券、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后,还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具。

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定

八、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时,基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于:(1)法律法规的限制;(2)标的指数成份股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)标的指数成份股进行配股或增发;(5)标的指数派发现金股息;(6)其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。

在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的,基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为沪深300指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2014年10月15日复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为2014年4月1日至2014年6月30日。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,416,052,642.01	98.78
	其中:股票	4,416,052,642.01	98.78
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	54,107,342.07	1.21
7	其他资产	427,811.75	0.01
8	合计	4,470,587,795.83	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而2的合计项不含可退替代款估值增值。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,043,398.00	0.32
B	采矿业	248,575,168.30	5.59
C	制造业	1,606,244,856.25	36.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	154,258,308.19	3.47
E	建筑业	139,753,300.55	3.14
F	批发和零售业	119,781,690.91	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	109,560,027.52	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,732,137.26	3.91
J	金融业	1,488,063,318.82	33.46
K	房地产业	203,041,984.65	4.57
L	租赁和商务服务业	41,994,235.06	0.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	40,376,720.02	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	38,412,232.81	0.86
S	综合	38,215,263.67	0.86
	合计	4,416,052,642.01	99.31

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	16,336,876	167,289,610.24	3.76
2	601318	中国平安	4,239,493	166,781,654.62	3.75
3	600016	民生银行	24,008,396	149,092,139.16	3.35
4	601166	兴业银行	10,125,090	101,554,652.70	2.28
5	600000	浦发银行	9,913,146	89,713,971.30	2.02
6	600030	中信证券	7,528,985	86,282,168.10	1.94
7	600837	海通证券	7,866,149	71,975,263.35	1.62
8	000002	万 科A	8,574,120	70,907,972.40	1.59
9	601398	工商银行	20,285,071	68,766,390.69	1.55
10	000651	格力电器	2,131,453	62,771,290.85	1.41

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	312,397.52
2	应收证券清算款	105,801.23
3	应收股利	-
4	应收利息	9,613.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	427,811.75

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2013年3月6日,基金合同生效以来(截至2014年6月30日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
基金合同生效至2013年12月31日	-7.40%	1.30%	-11.16%	1.34%	3.76%	-0.04%
2014年1月1日至2014年6月30日	-6.21%	1.03%	-7.08%	1.04%	0.87%	-0.01%
基金合同生效至2014年6月30日	-13.15%	1.21%	-17.45%	1.24%	4.30%	-0.03%

十三、费用概览

一、与基金运作相关的费用

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.基金合同生效后的标的指数许可使用费;
4.基金财产拨划支付的银行费用;
5.基金合同生效后的基金信息披露费用;
6.基金份额持有人大会费用;
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费;
8.基金的证券交易费用;
9.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
10.基金上市初费及年费;
11.基金收益分配中发生的费用;
12.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人如发现数据不符,及时联系托管人协商解决

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。

3.标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计算,逐日累计。

计算方法如下:

H=E×0.03%/当年天数
H为每日应付的标的指数许可使用费
E为前一日的基金资产净值。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币伍万元(50,000),计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的,本基金按照变更后的费率计提标的指数许可使用费,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

如果中证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法,应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

4.除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况针对全部或部分份额类别调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照相关法律法规规定在指定媒体上刊登公告。

调高基金管理费率或基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率或基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

二、与基金销售相关的费用

1. 场内申购、赎回的费用

申购费用由申购基金份额的投资人承担,赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。投资人在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准向投资人收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

2. 场外申购、赎回的价格及费用

(1)投资者在申购或赎回基金份额时,基金管理人参考当时市场的交易佣金、印花税等相关交易成本水平,收取一定的申购费和/或赎回费并归入基金资产,确保覆盖场外现金申赎引起的证券交易费用。当前的申购、赎回费率如下:

申购费率:0.05%
赎回费率:0.15%
本基金的申购费由申购人承担,赎回费由赎回人承担,申购费与赎回费均全部归入基金财产。
基金管理人可根据市场情况调整申购费率、赎回费率,经公告后实施。

(2)申购份额、赎回金额的计算方式:

1)申购份额的计算
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其通用的计算方式为:
净申购金额=申购金额-(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份数=净申购金额-T日基金份额净值
份额计算结果按四舍五入方法保留到整数位,申购费用以